



LDB
EMPRESAS

TAMBAÚ
AGOSTO 2021



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.08.2021.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **93,35%**

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,37	0,33	1,16	6.397.747,91	8,40	7.563.467.815,66	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,34	1,21	221.858,12	0,29	7.025.686.891,77	0,00
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,38	0,35	1,16	7.593.380,56	9,97	667.787.142,21	1,14
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,38	0,18	1,68	6.828.415,74	8,97	9.863.752.148,95	0,07
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,83	-1,97	-1,97	147.957,64	0,19	1.380.467.864,45	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,54	0,19	1,69	6.648.335,28	8,73	11.382.462.168,68	0,06
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,64	0,10	-0,13	4.993.501,30	6,56	5.975.243.184,05	0,08
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,91	-0,45	-1,37	12.215.804,70	16,04	8.803.716.462,71	0,14
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,62	-1,45	-2,36	449.167,33	0,59	15.341.053.159,31	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,66	0,04	0,64	45.496.168,58	59,74		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,27	0,42	1,96	2.079.192,50	2,73	9.405.501.513,40	0,02
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,18	0,49	2,34	11.299.433,00	14,84	3.865.180.591,77	0,29
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,19	0,45	2,17	82.612,01	0,11	4.685.526.156,09	0,00
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO H FI RF NILO	6,52	-1,59	-2,28	1.954.440,28	2,57	779.798.063,25	0,25
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,79	0,08	0,74	5.085.558,10	6,68	1.164.277.281,46	0,44
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	3,21	-0,45	-0,96	5.096.474,24	6,69	4.477.081.866,50	0,11
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,21	0,06	1,08	25.597.710,13	33,61		
Renda Fixa			1,51	0,05	0,79	71.093.878,71	93,35		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,45%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADESCO	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	19,70	-3,66	-7,80	92.200,26	0,12	264.137.167,26	0,03
CEF	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	19,76	-2,95	11,53	1.206.722,84	1,58	625.056.895,75	0,19
BB	BB	BB AÇÕES AGRO FIC FI	15,75	-3,44	-7,13	928.677,14	1,22	374.966.098,33	0,25
BB	BB	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	14,87	3,26	10,38	1.052.502,43	1,38	2.061.473.105,53	0,05
BB	BB	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	20,01	-2,06	-7,80	201.742,15	0,26	1.334.650.536,18	0,02
BRAM	BEM	BRADESCO FIC EM AÇÕES CRESCIMENTO	19,81	-1,87	-1,87	196.259,54	0,26	51.336.008,82	0,38
CEF	CEF	FIA CAIXA SEGURIDADE	38,10	-6,71	-6,71	9.133,53	0,01	1.106.386.695,12	0,00
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			14,80	-1,36	14,25	3.687.237,89	4,84		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,29	0,31	0,31	208.121,00	0,27	7.594.007.474,53	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	14,91	2,47	2,47	1.019.773,63	1,34	274.681.867,73	0,37
Sub-total Artigo 8º III			7,44	1,92	1,92	1.227.894,63	1,61		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			14,45	-0,67	15,04	4.915.132,52	6,45		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,20%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	20,09	0,64	0,64	151.816,80	0,20	3.230.077.335,87	0,00
Sub-total Artigo 9º A, III			20,09	0,64	0,64	151.816,80	0,20		
Investimentos no Exterior			14,27	0,64	0,64	151.816,80	0,20		
Total			1,58	0,00	0,67	76.160.828,03	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	45.496.168,58	59,74	0,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	25.597.710,13	33,61	0,00	33,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	71.093.878,71	93,35					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	3.687.237,89	4,84	0,00	15,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	1.227.894,63	1,61	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	4.915.132,52	6,45					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	151.816,80	0,20					10,00
	Total Investimentos no Exterior	151.816,80	0,20					10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,04 8,81	0,64 31,10	0,06 5,42	1,12 63,28	2,64 97,57	15.047,09	328.733,55
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,06 14,05	1,08 52,38	0,37 33,97	1,33 75,38	2,45 90,74	16.108,89	263.038,10
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,36 1,12	14,25 10,07	-3,91 1,98			-48.705,29	-99.517,00
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	1,92 5,36	1,92 5,36				20.398,76	20.398,76
Artigo 9º A, III % do CDI	0,64 199,54	0,64 199,54				961,32	961,32
TAMBAÚ (Total)						3.810,77	513.614,73

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	12.270.886,00	0,00	0,00	0,00	12.215.804,70	-55.081,30	-170.152,76
BB PREV RF IDKA2	6.816.250,93	0,00	0,00	0,00	6.828.415,74	12.164,81	223.120,56
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	4.988.333,64	0,00	0,00	0,00	4.993.501,30	5.167,66	-6.498,70
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	6.376.421,32	0,00	0,00	0,00	6.397.747,91	21.326,59	85.717,42
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	8.565.998,75	0,00	-1.000.000,00	0,00	7.593.380,56	27.381,81	109.259,06
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.635.441,08	0,00	0,00	0,00	6.648.335,28	12.894,20	92.013,16
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	150.937,26	0,00	0,00	147.957,64	-2.979,62	-2.979,62
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	204.275,09	28.936,86	-12.133,60	0,00	221.858,12	779,77	9.087,10
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	455.774,16	0,00	0,00	0,00	449.167,33	-6.606,83	-10.832,67
					45.496.168,58	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	5.119.762,74	0,00	0,00	0,00	5.096.474,24	-23.288,50	-49.216,19
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	82.244,27	0,00	0,00	0,00	82.612,01	367,74	5.801,14
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	2.070.498,92	0,00	0,00	0,00	2.079.192,50	8.693,58	43.441,56
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	11.886.591,80	0,00	-645.179,54	0,00	11.299.433,00	58.020,74	273.607,73
BRADESCO H FI RF NILO	1.985.979,35	0,00	0,00	0,00	1.954.440,28	-31.539,07	-45.559,72
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	5.081.703,70	0,00	0,00	0,00	5.085.558,10	3.854,40	34.963,58
					25.597.710,13	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES AGRO FIC FI	961.742,07	0,00	0,00	0,00	928.677,14	-33.064,93	-71.322,86
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	1.019.284,25	0,00	0,00	0,00	1.052.502,43	33.218,18	52.502,43
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	205.983,52	0,00	0,00	0,00	201.742,15	-4.241,37	-17.044,24
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	95.701,26	0,00	0,00	0,00	92.200,26	-3.501,00	-7.799,74
BRADESCO FIC EM AÇÕES CRESCIMENTO	0,00	200.000,00	0,00	0,00	196.259,54	-3.740,46	-3.740,46
FIA CAIXA SEGURIDADE	0,00	9.777,27	0,00	0,00	9.133,53	-643,74	-643,74
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	1.243.454,81	0,00	0,00	0,00	1.206.722,84	-36.731,97	-51.468,39
					3.687.237,89	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,00	207.495,87	0,00	0,00	208.121,00	625,13	625,13
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	0,00	1.000.000,00	0,00	0,00	1.019.773,63	19.773,63	19.773,63
					1.227.894,63	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,00	150.855,48	0,00	0,00	151.816,80	961,32	961,32
					151.816,80	0,00	0,00

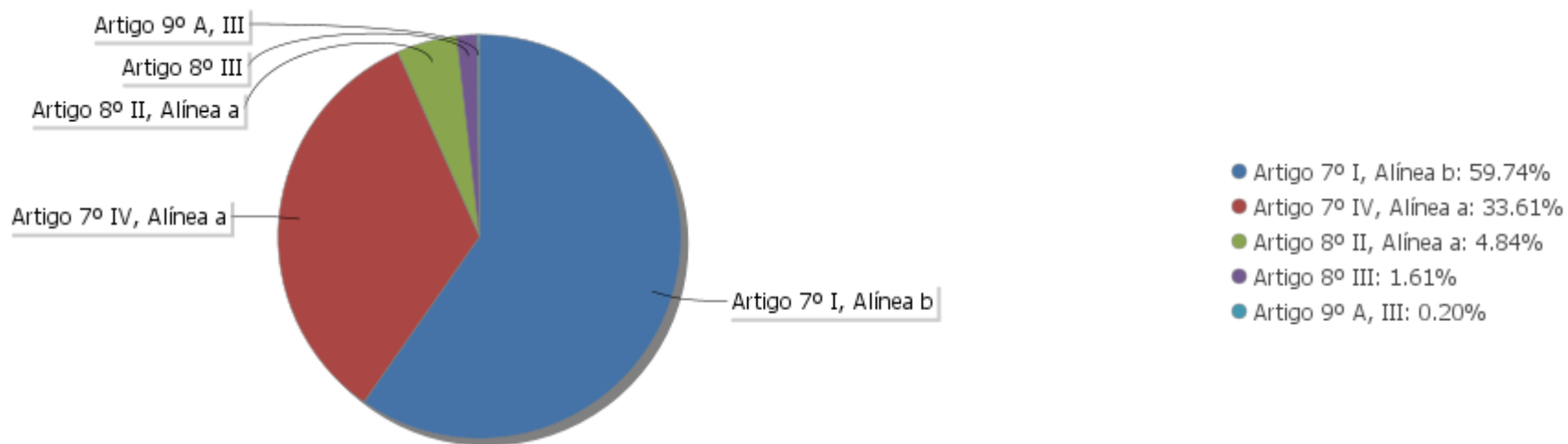
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

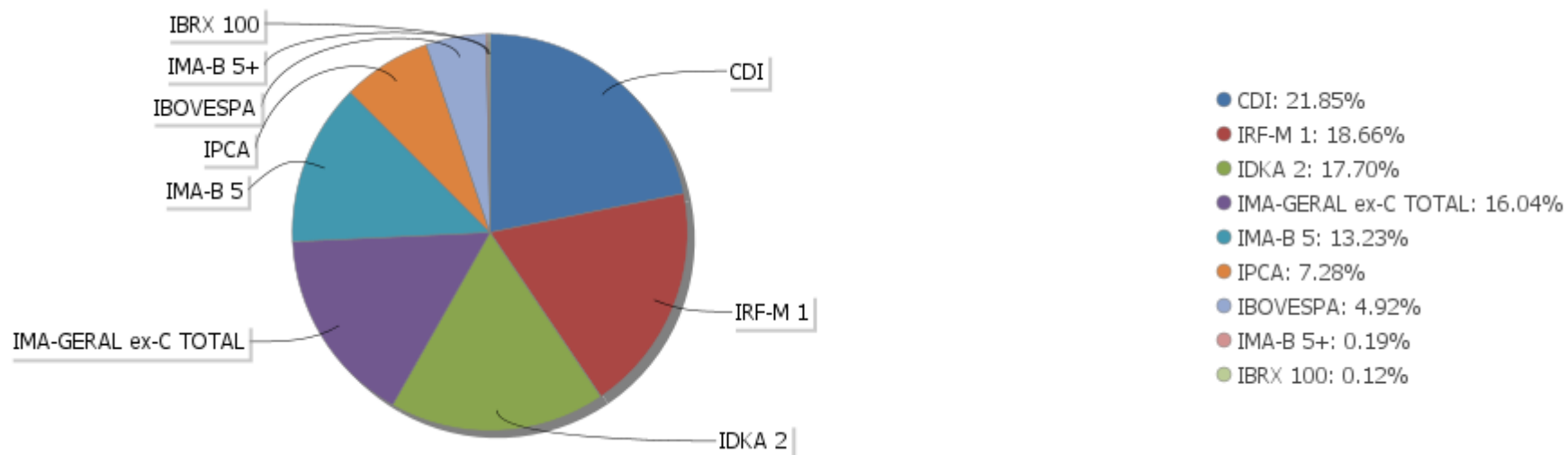
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	76.160.828,03	100,00	76.160.828,03	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	76.160.828,03	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	76.160.828,03	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

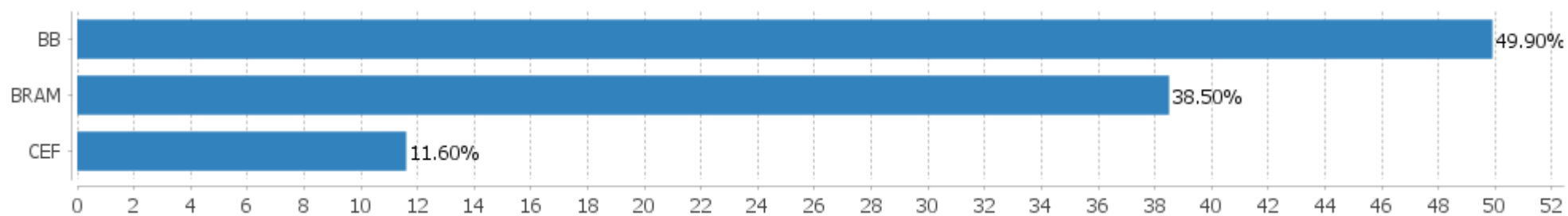


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,04	-0,36	0,05	0,56	0,48	0,06	-0,08	0,00					0,67
IPCA + 5,89%	0,71	1,27	1,46	0,77	1,31	1,01	1,47	1,38					9,76
p.p. indexador	-0,75	-1,63	-1,41	-0,21	-0,83	-0,95	-1,54	-1,37					-9,09
2020	0,41	0,40	-0,54	0,38	0,84	0,58	0,70	0,02	-0,14	0,12	0,63	1,15	4,64
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,30	-0,26	-1,11	0,24	0,76	-0,15	-0,19	-0,70	-1,26	-1,22	-0,72	-0,71	-6,01

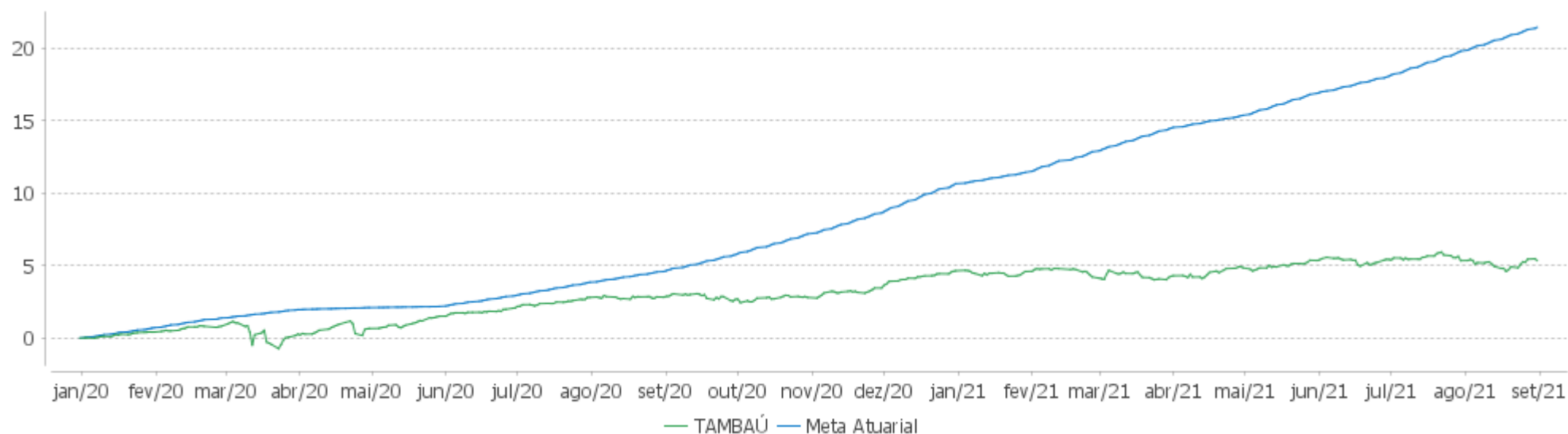
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

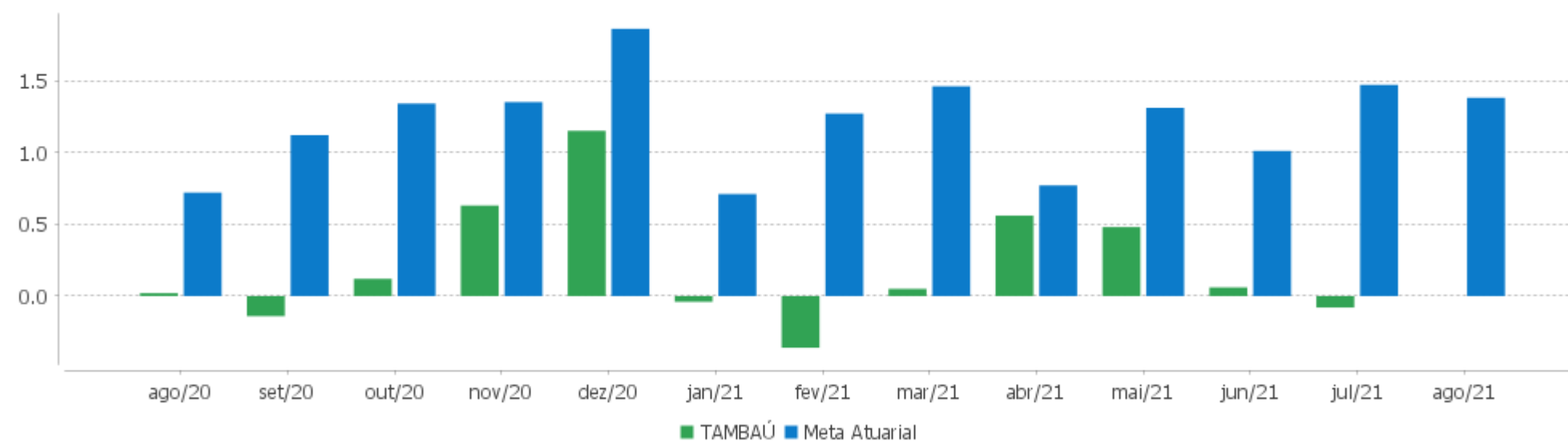
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	2	10,00	03 meses	-0,01	3,90	-3,92	1,84
Meses abaixo - Meta Atuarial	18	90,00	06 meses	1,08	7,62	-6,54	1,77
			12 meses	2,45	16,11	-13,66	1,58
			24 meses				
Desde 31/12/2019				5,34	21,45	-16,11	1,95
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	1,15	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BRADESCO H FI RF NILO % do CDI	-1,59 -374,43	-3,69 -179,11	-1,84 -168,63	-0,86 -48,55	1,88 69,65	9,25 138,38	41,07 306,92
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,08	0,74 -0,73	-0,08 -0,13	1,56 -0,41	3,79 -0,98	13,37 -1,09	29,60 -1,36
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,49 115,39	2,34 113,48	1,23 113,42	2,00 113,12	2,87 106,32	6,21 92,99	12,81 95,73
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do CDI	0,42 99,00	1,96 95,03	1,11 101,80	1,72 96,86	2,37 87,64	6,12 91,54	12,59 94,08
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,45 105,42	2,17 105,51	1,17 107,82	1,91 107,74	2,78 102,89	6,29 94,15	12,84 95,94
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	-0,45 -1,32	-0,96 -6,63	-0,52 -2,90	0,44 -4,07	1,76 -7,92		
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,18 -0,09	1,68 -0,27	0,17 0,40	2,06 -0,23	5,08 0,00	14,20 -1,08	27,71 -2,07
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,45 -0,11	-1,37 -0,59	-0,59 -0,47	0,09 -0,40	0,99 -0,31	7,10 -0,44	24,38 0,06
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS Var. IRF-M 1 p.p.	0,35 -0,02	1,16 -0,21	0,75 -0,02	1,15 -0,14	1,87 -0,37	6,72 -0,69	14,37 -0,99
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-1,45 -2,32	-1,51 -7,19	-2,22 -4,60	-1,04 -5,55	-0,01 -9,69	9,20 -3,15	27,34 11,13
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,33 -0,03	1,16 -0,22	0,68 -0,09	1,12 -0,17	1,83 -0,40	6,69 -0,72	14,37 -0,99
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,19 -0,07	1,69 -0,26	-0,15 0,08	2,10 -0,20	4,83 -0,25	14,10 -1,18	27,77 -2,02
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,10 -0,05	1,30 -0,17	-0,06 -0,11	1,82 -0,14	4,51 -0,25	13,87 -0,58	30,03 -0,93
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,34 -0,02	1,21 -0,16	0,70 -0,07	1,17 -0,12	2,00 -0,24	6,95 -0,46	14,68 -0,67
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,36 -0,14	-5,68 -0,24	-2,36 -0,19	-1,74 -0,21	1,53 -0,27	5,86 -0,74	45,50 -1,82
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	3,29 776,69	22,48 1.091,22	8,67 796,90	19,63 1.108,77	30,01 1.110,39	52,98 792,78	57,85 432,29
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,43	2,04	1,03	1,68	3,26	8,17	16,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	100,92	98,83	94,36	94,68	120,68	122,25	126,95
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	-2,95 -0,47	10,96 11,15	-8,28 -2,38	15,07 7,12	29,81 10,28	33,79 16,34	
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA Var. IBRX 100 p.p.	-3,66 -0,40	-0,82 -1,89	-6,68 -0,15	5,85 -2,11	17,82 -3,06	18,37 -1,15	61,74 0,55
BRANCO FIC EM AÇÕES CRESCIMENTO Var. IBOVESPA p.p.	-2,54 -0,06	6,78 6,98	-4,68 1,21	10,62 2,67	16,80 -2,73		
BB AÇÕES AGRO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,44 -0,96	4,61 5,04	-7,44 -1,55	8,43 0,48			
FIA CAIXA SEGURIDADE Var. IBOVESPA p.p.	-9,87 -7,40	2,32 2,42	-19,66 -13,77				
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,26 5,74	21,92 22,12	8,58 14,47	19,23 11,28	29,64 10,10		
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-2,06 0,42	0,75 0,95	-5,54 0,35	11,42 3,47	22,72 3,19	32,58 15,13	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,44 4,91	17,01 17,21	6,70 12,59	6,82 -1,12	16,19 -3,35	96,21 78,76	100,73 45,82
TAMBAÚ Var. IPCA + 5,89% p.p.	0,00 -1,37	0,67 -9,09	-0,01 -3,92	1,08 -6,54	2,45 -13,66		
CDI	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,37	1,37	0,77	1,29	2,24	7,41	15,36	23,32	39,53
IRF-M 1+	-1,11	-5,18	-1,73	-1,87	-3,32	6,96	28,83	35,92	63,00
IRF-M TOTAL	-0,60	-2,63	-0,86	-0,67	-1,25	7,35	25,24	32,67	56,55
IMA-B 5	0,15	1,47	0,05	1,97	4,77	14,45	30,97	39,69	59,11
IMA-B 5+	-2,22	-5,44	-2,16	-1,52	1,80	6,60	47,32	51,19	76,06
IMA-B TOTAL	-1,09	-2,17	-1,04	0,19	3,27	10,12	40,44	46,85	69,60
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,34	-0,78	-0,12	0,49	1,31	7,55	24,32	31,67	51,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,41	-0,37	-0,16	0,57	1,87	8,50	25,67	33,36	53,41
IDKA 2	0,26	1,95	-0,23	2,29	5,08	15,28	29,79	40,22	60,31
IDKA 20	-4,42	-9,21	-4,78	-4,01	0,70	0,45	60,91	59,85	88,93
CDI	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38	21,14	35,76

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91	67,69	105,15
IBRX 100	-3,25	1,07	-6,53	7,96	20,88	19,52	61,19	73,03	111,89
IBRX 50	-3,50	1,23	-6,61	8,25	22,12	19,45	54,17	67,38	104,18
SMALL CAP	-3,82	0,95	-8,23	6,49	16,98	24,03	87,36	82,99	149,92
IFIX	-2,63	-4,19	-2,37	-4,74	-1,16	3,51	28,53	31,95	55,61
Índice Consumo - ICON	-3,90	-5,90	-8,34	0,65	0,42	6,20	60,80	43,37	64,23
Índice Dividendos - IDIV	-0,50	-0,20	-4,33	10,92	19,40	15,05	72,87	73,37	131,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,87	5,67	2,38	4,51	9,68	12,35	16,21	21,08	24,05
INPC	0,88	5,94	2,52	4,79	10,42	13,67	17,40	21,68	23,78
IGPM	0,66	16,75	2,06	11,01	31,12	48,19	55,53	69,35	66,46
SELIC	0,42	2,06	1,09	1,77	2,70	6,68	13,38	21,15	35,79

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,34	19,17	5,75	10,37	21,46	92,07	93,87	199,05	230,68
MSCI ACWI	2,79	13,52	2,42	4,91	19,14	80,33	76,32	153,23	182,42
MSCI World	2,78	15,58	3,77	7,14	20,26	82,56	79,59	161,97	189,98

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,22	8,46	3,42	6,63	14,05	21,50	30,63	41,51	50,76
IPCA + 5,00%	1,30	9,15	3,67	7,15	15,14	23,85	34,42	47,00	58,11
IPCA + 5,50%	1,34	9,49	3,80	7,41	15,69	25,03	36,34	49,80	61,89
IPCA + 5,89%	1,38	9,76	3,90	7,62	16,11	25,95	37,85	52,02	64,89
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28	52,65	65,74
INPC + 4,00%	1,23	8,73	3,56	6,92	14,82	22,92	31,98	42,21	50,44
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70	53,40	65,38

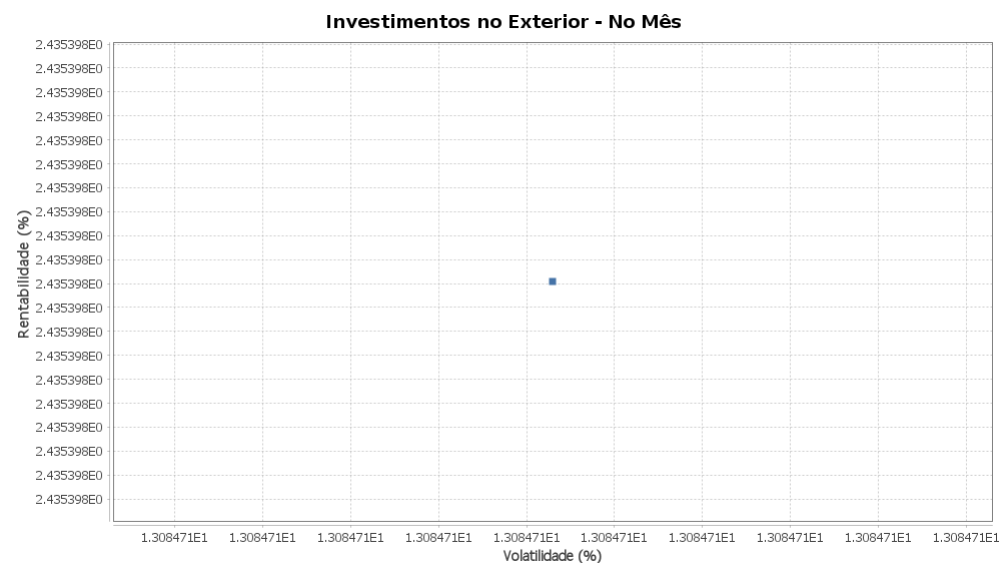
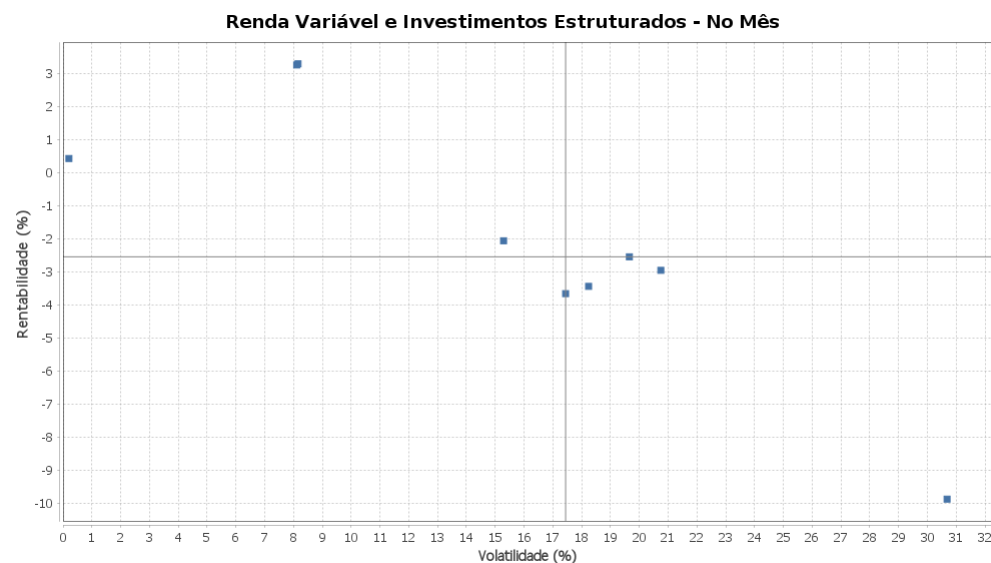
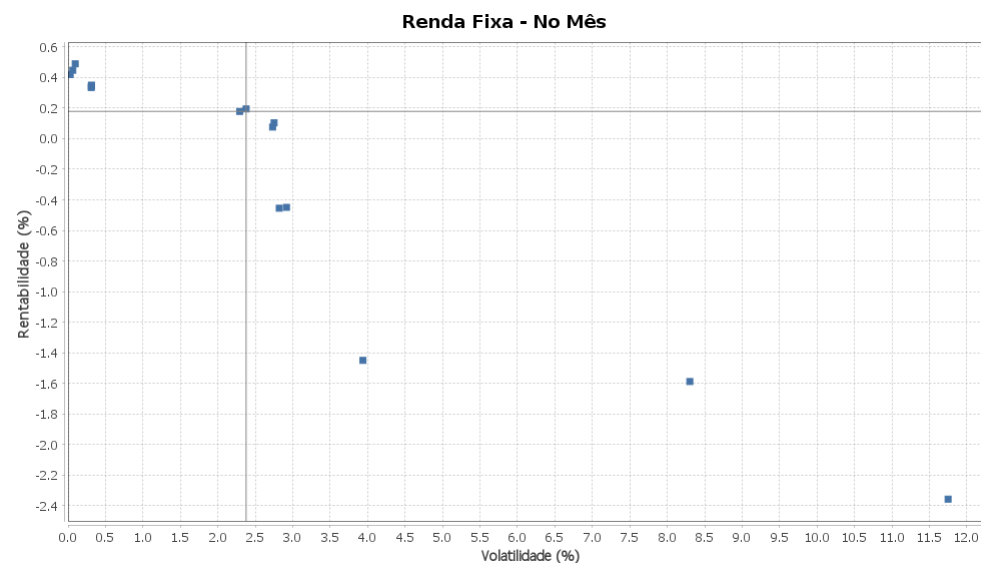
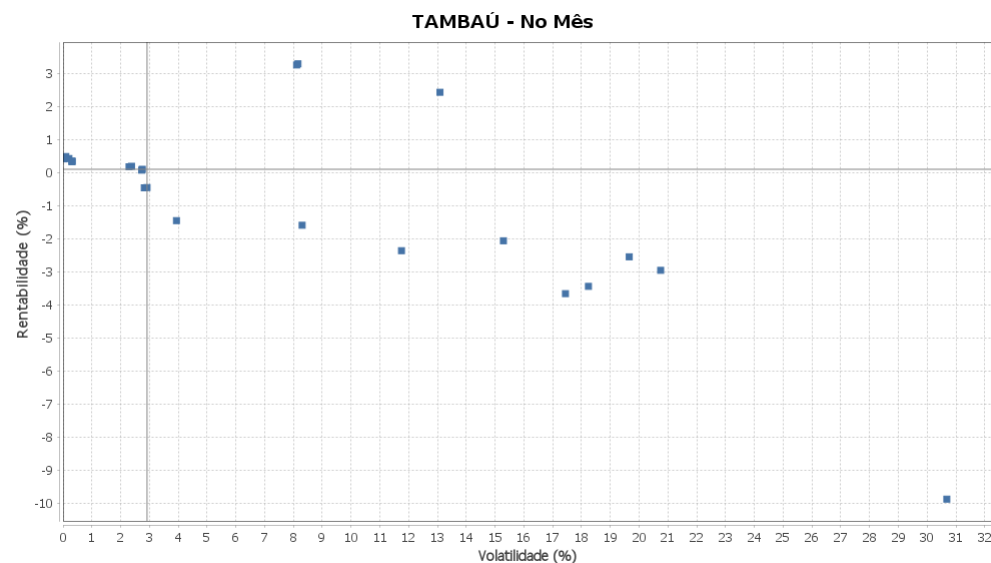
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
88	06/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.414,85	0,00	10.019,83114696	2,6362570000
93	06/08/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	150.937,26	0,00	55.786,63203255	2,7056170000
118	06/08/2021	FIA CAIXA SEGURIDADE	8.632,70	0,00	7.870,85621400	1,0967928100
101	09/08/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	150.855,48	0,00	24.717,61822899	6,1031560000
94	09/08/2021	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	200.000,00	0,00	53.262,51269800	3,7549861970
98	09/08/2021	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	200.000,00	0,00	56.935,34408092	3,5127565000
119	11/08/2021	FIA CAIXA SEGURIDADE	1.144,57	0,00	1.055,41196300	1,0844772000
99	12/08/2021	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	800.000,00	0,00	226.367,98203725	3,5340687000
97	12/08/2021	BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,00	1.000.000,00	384.783,41657353	2,5988646000
100	13/08/2021	BRADESCO FIC EM AÇÕES CRESCIMENTO	200.000,00	0,00	118.619,50853209	1,6860633000
89	17/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.200,00	833,60646575	2,6391350000
95	20/08/2021	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	7.495,87	0,00	1.993,03879400	3,7610256370
90	30/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.736,88	3.682,43738985	2,6441400000
91	30/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	196,72	74,39848117	2,6441400000
96	30/08/2021	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	645.179,54	51.328,82954449	12,5695354000
92	31/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.522,01	0,00	953,63434583	2,6446300000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 721.243,54

Value-At-Risk: 0,95%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,04	-0,00	-0,15	0,42	2.079.192,50	2,73
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,03	0,00	0,36	0,45	82.612,01	0,11
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	Artigo 7º IV, Alínea a	0,10	0,04	-0,00	0,68	0,49	11.299.433,00	14,84
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	Artigo 8º III	0,20	0,08	0,00	0,02	0,43	208.121,00	0,27
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,17	0,01	-0,29	0,33	6.397.747,91	8,40
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,17	0,00	-0,26	0,34	221.858,12	0,29
BRADESCO FI RF IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,18	0,01	-0,24	0,35	7.593.380,56	9,97
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,29	1,09	0,09	-0,11	0,18	6.828.415,74	8,97
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,38	1,14	0,09	-0,10	0,19	6.648.335,28	8,73
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	Artigo 7º IV, Alínea a	2,73	1,28	0,08	-0,13	0,08	5.085.558,10	6,68
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,75	1,27	0,08	-0,12	0,10	4.993.501,30	6,56
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	2,82	1,22	0,08	-0,31	-0,45	5.096.474,24	6,69
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,92	1,21	0,18	-0,30	-0,45	12.215.804,70	16,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,94	1,48	0,01	-0,48	-1,45	449.167,33	0,59
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIA	Artigo 8º II, Alínea a	8,11	5,52	0,03	0,35	3,26	1.052.502,43	1,38
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	Artigo 8º III	8,16	5,54	0,03	0,35	3,29	1.019.773,63	1,34
BRADESCO H FI RF NILO	Artigo 7º IV, Alínea a	8,30	3,45	0,08	-0,24	-1,59	1.954.440,28	2,57
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	11,75	4,18	0,01	-0,24	-2,36	147.957,64	0,19
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	13,08	7,38	-0,00	0,15	2,44	151.816,80	0,20
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	15,29	7,28	0,01	-0,16	-2,06	201.742,15	0,26
BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	Artigo 8º II, Alínea a	17,44	6,66	0,01	-0,23	-3,66	92.200,26	0,12
BB AÇÕES AGRO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	18,24	7,33	0,05	-0,21	-3,44	928.677,14	1,22
BRADESCO FIC EM AÇÕES CRESCIMENTO	Artigo 8º II, Alínea a	19,65	6,88	0,01	-0,15	-2,54	196.259,54	0,26
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	Artigo 8º II, Alínea a	20,75	7,97	0,09	-0,16	-2,95	1.206.722,84	1,58
FIA CAIXA SEGURIDADE	Artigo 8º II, Alínea a	30,68	20,34	0,00	-0,34	-9,87	9.133,53	0,01